


برای استفاده از سامانه **سب‌بان** و امکانات بهینه سازی سب‌بند ابتدا باید در سایت **سب‌بان** به آدرس www.sabadban.com ثبت نام نمایید. برای این کار تنها به یک آدرس ایمیل و یک شماره تلفن همراه نیاز دارید و نیازی به پرداخت هزینه برای ثبت نام در سایت **سب‌بان** نیست.



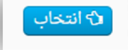
ثبت نام در سایت سب‌بان

پس از ثبت نام در سایت و ورود به سامانه ی **سب‌بان** امکاناتی در اختیار شما قرار خواهد گرفت که به سهولت بتوانید برای متنوع سازی و بهینه کردن سب‌سهم تان، پارامترهایی نظیر "سود و زیان"، "مقدار ریسک" و "شاخص نسبت شارب" را بسنجید. برای آشنایی با این محاسبات می توانید از مطالب [ویلاگ سب‌بان](#) استفاده نمایید و یا از فیلم های آموزشی **سب‌بان** بهره ببرید. پس از ورود به سامانه شما با صفحه ی زیر مواجه خواهید شد.



حالا با طی چند مرحله ی ساده شما موفق به ساخت سبدهای سهام متعددی خواهید شد. توجه داشته باشید که ساخت سبد برای استفاده ی شما از امکانات محاسبه و تحلیل **سبدها** اجباری نیست. شما می توانید بدون ساخت سبد از بخش بالای همین صفحه از "پردازش" استفاده نمایید. اما بهتر است برای حفظ نظم و طبقه بندی پردازش هایتان نسبت به ساخت سبد اقدام فرمایید. برای ساخت سبد سهام مورد نظرتان، کافی است نامی انتخاب کنید، این نام را در قسمت  وارد نمایید و آنرا اضافه نمایید. پس از انجام این مرحله شما یک سبد سهام ساخته اید. ما در این راهنما سبدها را به نام "سهام شرکت های بزرگ" نامگذاری کرده ایم.



در همین صفحه شما می توانید سبدهای متعددی را با نام های مختلف بسازید تا بهترین تصمیم را برای سرنوشت سرمایه تان بگیرید. حالا شما باید سهام مورد نظرتان را به این سبدها اضافه نمایید. برای اضافه نمودن سهام، بررسی وضعیت سبد و عملیات دیگر ابتدا باید با استفاده از  در کنار عنوان سبد، سبد مورد نظرتان را انتخاب نمایید. پس از انتخاب یک سبد، صفحه زیر به نمایش در خواهد آمد.

خانه / پردازش

شما در **سهم شرکتهای بزرگ** می‌باشید. تغییرات روی آن فقط پس از ذخیره دستی یا پردازش ثبت می‌گردد. بجای آن می‌توانید در **پوشه کارکنید**.

توجه به تاریخ عرضه سهام دقت فرمایید! در صورتیکه بین نمادهای انتخابی اختلاف بازه تاریخی موجود باشد پیش‌بینی دوره بر اساس بزرگترین بازه تاریخی صورت می‌گیرد.

اقلام پرتفوی




نماد

نماد	عنوان	تاریخ عرضه	آخرین نرخ	تعداد سهم*	ارزش
					Σ 0

فهرست شما خالی است. جهت ادامه نمادهای مورد نظر را اضافه نمایید.

اینجاست که شما باید سهامی را که مد نظرتان است به سبدتان اضافه کنید. برای این کار به سادگی نام سهام مورد نظرتان را در قسمت "اقلام پرتفوی" جستجو فرمایید. در قسمت "اقلام پرتفوی"، **سبدها** به صورت پیش فرض نام نمادها را برای شما ذخیره کرده است و جهت جلوگیری از اشتباه آنها را به شما پیشنهاد می‌دهد. بنابراین اگر نام‌های پرطمطراق شرکت‌ها را به خاطر نسپرده‌اید، دانستن بخشی از نام شرکت مورد نظر برای پیدا کردن آن کافیست.

شما می‌توانید از  برای اضافه نمودن نماد به سبد مورد نظر استفاده کنید. مراقب باشید که  کل سهام انتخاب شده را از سبد حذف می‌کند و  نیز سبد سهام مرتب شده را ذخیره می‌کند. ما به طور مثال در این بخش پنج نماد "فولاد، وغدیر، وملت، دانا و شبندر" را به سبد "سهام شرکت‌های بزرگ" اضافه کرده ایم. شما می‌توانید هر چقدر می‌خواهید نمادهای دلخواهتان را به همین شکل در سبدتان اضافه کنید. همینطور که در شکل زیر پیداست قادر خواهید بود تاریخ عرضه نماد مورد نظرتان را به بازار بورس و قیمت نهایی آن را هم در بازار مشاهده کنید.

اقلام پرتفوی

نماد

🗑️ 📄 +

نماد	عنوان	تاریخ عرضه	آخرین نرخ	تعداد سهم*	ارزش
دانا	بیمه دانا	1389/05/20	11,220	0	0
شبندر	پالایش نفت بندرعباس	1391/01/28	24,730	0	0
فولاد	فولاد مبارکه اصفهان	1385/12/20	11,690	0	0
وبملت	بانک ملت	1387/11/27	23,860	0	0
وغدیر	سرمایه گذاری غدیر(هلدینگ)	1380/01/05	12,240	0	0
					Σ 0

می بینید که "تنوع سهام" شما تامین و پارامترهای مربوط به آن در حافظه ی **سیدبان** محاسبه شده است. اکنون نوبت آن است تا شما هم از تحلیل سامانه ی هوشمند **سیدبان** نسبت به انتخاب هایتان باخبر شوید. به همین منظور به بخش "پارامترهای پردازش" توجه فرمایید. در این بخش پارامترهای متعدد محاسباتی در تخمین وضعیت آینده ی سبد شما قابل دسترسی و تغییرند. خواهید دید که برخی از این پارامترها نیز غیر قابل تغییر هستند.

تغییر همه ی این پارامترها نیازمند تسلط سطح بالا و حرفه ای به الگوریتم های مدرن ریاضی و آماری است که در بهینه سازی سبد استفاده می شود. اما در صورت تمایل به دسترسی به این پارامترها، در قسمت کاربری می توانید پلن مربوط به مشاوران را خریداری فرمایید.

پارامترهای پردازش

نوع پردازش: بهترین، بی تفاوت، ...

مدل ریسک: لودو-اولف

تابع هدف: حداکثر شارپ

تناوب دوره: روزانه

تاریخ پس از: 1391/03/11

تغییر ضرایب: پردازش

نکته مهم در خصوص پلن های مختلف سبدها

اگر شما هنوز از پلن های سبدها خریداری نکرده اید به معنای آن نیست که نمی توانید از امکانات این سامانه استفاده کنید. شما بدون پرداخت هزینه ماهیانه تا "پنج" بار می توانید از امکان محاسبات و پردازش سبدها استفاده نمایید. در صورت تمایل به استفاده بیشتر از سبدها می بایست به بخش "کاربری" بالای همین صفحه مراجعه فرمایید و پلن های متنوع سبدها را خریداری نمایید. روشن است که اگر شما به عنوان یک مشاور مالی فعالیت می کنید و یا به تحلیل بازار به شکل جدی تری نیاز یا علاقه دارید، این پلن ها برای شما بسیار کارآمدند. تیم تحلیلی سبدها جهت استفاده کاربران پلن های عادی، بهترین پارامترها، بهترین الگوها و دو تابع هدف (حداکثر شارپ و حداقل نوسان) را به صورت پیشفرض برای این سطح از دسترسی قرار داده است تا کاربران پلن های عادی ضمن بهره بردن از آنها، دچار خطای محاسباتی و تحلیلی نشوند. در صورت نیاز به استفاده از پارامترها و توابع هدف بیشتر، می توانید پلن مربوط به مشاورین مالی را خریداری فرمایید.

با نگاهی به بخش پارامترهای پردازش خواهید دید که در پلن کاربران عادی شما با دو پارامتر روبرو هستید: "نوع پردازش" و "تابع هدف".


الف : نوع پردازش

در قسمت "نوع پردازش" شما قادرید از **سبدها** به دو منظور مختلف استفاده نمایید :

1- **بهترین پرتفوی** : در این حالت لازم نیست تعداد هر سهم را در نماد مورد نظرتان مشخص کنید. شما تنها نماد های مورد

نظرتان را انتخاب می کنید و **سبدها** بر طبق الگوریتم هایش تعداد خرید هر سهم (درصد خرید) را به شما پیشنهاد

دهد.

2- **ارزیابی پرتفوی** : فرض می کنیم شما تصمیم تان در مورد نمادهای دلخواهتان و تعداد سهم هر نماد را از قبل گرفته اید و یا از قبل سهامی را خریده اید. با انتخاب این گزینه، **سبدبان** تنها وضعیت آینده ی سبد شما را با ابزار گوناگونی به اطلاعاتتان خواهد رساند. برای تعیین تعداد مورد نیاز هر سهم می بایست از  استفاده نمایید. طبق شکل زیر در صفحه باز شده تعداد سهم را وارد کنید. با انتخاب "جایگزینی و ثبت" تعداد سهام را قطعی نمایید و سپس به صورت خودکار به صفحه ی اصلی برمی گردید.



نکته قابل توجه :

در حالت "ارزیابی پرتفوی"، سبدبان یکی از دغدغه های دائمی همه ی سهامداران بازار سرمایه را مرتفع خواهد کرد. بسیاری از سهامدارانی که سبدهای متنوعی در بازار دارند، به طور دائمی درگیر این مساله هستند که خرید سهام جدید، چه تاثیری در وضعیت کنونی سبد آنها دارد. آیا این خرید امری درست است یا نه؟ اینجا می توانید پس از ساختن سبد و اضافه کردن سهامتان به سبد و نیز تعیین تعداد سهام مورد مالکیت، سهم جدیدی را که در مورد آن هنوز تصمیم نگرفته اید را به سبد اضافه کنید. از امکانات پردازش استفاده کنید و تغییرات را در نسبت شارپ سبدتان مشاهده فرمایید. افزایش یا کاهش نسبت شارپ، خیال شما را از بابت خرید یا صرف نظر از سهام جدید راحت می کند. در الگوریتم هایی که "بازده و ریسک" در آنها کمیت های "با اهمیتی" هستند، کاهش نسبت شارپ به معنای آن است که اضافه کردن سهام جدید به سبد کار اشتباهی است.

حالا پس از انتخاب پارامترهای پردازشی مد نظر، قادر خواهید بود "تاریخی مشخص" را مبدا محاسبات خود قرار دهید. به صورت پیشفرض تاریخ پردازش برای هر سهم واحد 45 روز بعد از عرضه اولیه، به جهت خنثی نمودن افزایش مرسوم در این دوره است. به طور مثال تاریخ 1391/03/11 که در این راهنما به صورت پیشفرض سامانه **سبدهان** در نظر گرفته شده است، 45 روز پس از تاریخ عرضه **ی جوانترین** سهم سبد یعنی شبندر لحاظ شده است. بسیار مهم است که بدانید انتخاب تاریخ های قدیمی تر، از آنجا که اطلاعات آماری بیشتری را فراهم میکند، در بهبود فرآیند محاسبات **سبدهان** به شدت موثر است. بنابراین هر چقدر محدوده تاریخ بزرگ تری را انتخاب کنید به اطلاعات معتبرتری دست پیدا خواهید کرد. اما باید تمامی نمادها در بازه انتخابی دارای سابقه باشند در غیر اینصورت رویه عمل آنها به کل بازه تعمیم داده شده و نتایج درستی گرفته نمی شود. لذا در صورتی اقدام به تغییر دستی تاریخ نمائید که تمامی نمادهای سبد انتخابی در آن بازه دارای داده باشند. بر همین مبنا استفاده از **سبدهان** برای تحلیل سهامی که تازه پا به عرضه در بورس گذاشته است (به طور مثال هنگام عرضه اولیه یا سهامی با تاریخ عرضه کمتر از شش ماه) چندان توصیه نمی شود. این به این معنا نیست که **سبدهان** در انجام محاسبات سهام جوان بازار ناکارآمد است بلکه واقعیت الگوریتم بهینه سازی این محدودیت را ایجاد می کند.

نکته: برای ارزیابی و مقایسه دو سبد مختلف برای تصمیم گیری نهایی، حتما روزهای سابقه دو سبد را باید یکسان انتخاب کنید.

ب: تابع هدف

در قسمت تابع هدف می توانید توابع مختلفی را جهت محاسبات بهینه سازی پرتفوی خود انتخاب کنید. توابع حداکثر شارپ و حداقل نوسان در اختیار کاربران پلن های عادی **سبدهان** قرار گرفته است. برای استفاده از توابع ریسک کارا، بازده کارا و حداکثر مطلوبیت درجه دو می بایست از کاربران پلن مخصوص مشاورین **سبدهان** باشید.

1- حداکثر شارپ : محاسبات بهینه سازی با حداکثر کردن نسبت شارپ یا بازده مبتنی بر ریسک، انجام می شود.

2- حداقل نوسان : بهینه سازی با حداقل کردن میزان نوسان (ریسک) انجام می شود.

3- ریسک کارا : نسبت شارپ را برای سطح مشخصی از ریسک حداکثر می کند. (مختص به پلن کاربری مشاوران مالی)

4- بازده کارا : برای میزان بازده مشخص حداقل ریسک را محاسبه می کند. (مختص به پلن کاربری مشاوران مالی)

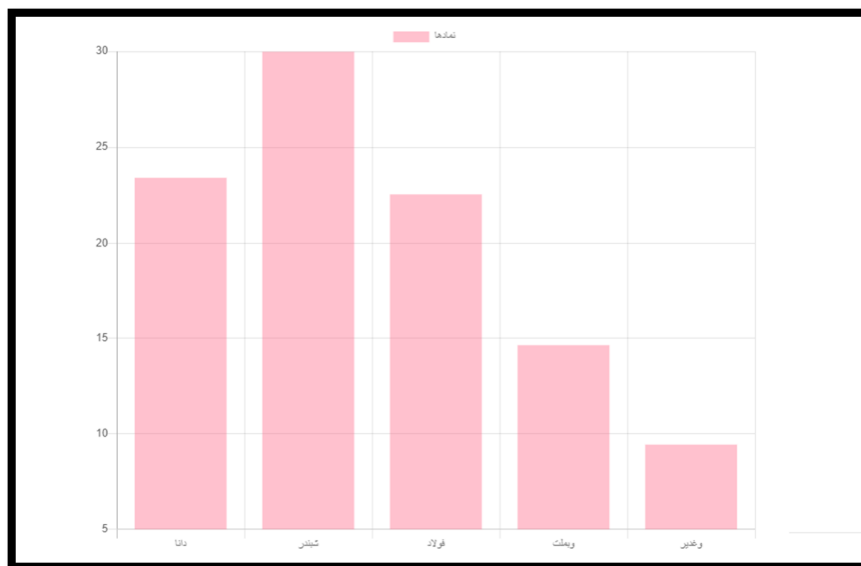
5- حداکثر مطلوبیت درجه دو : دستیابی به حداکثر بازده و حداقل ریسک به صورت همزمان میسر میشود. (مختص به پلن کاربری مشاوران مالی)

کاربری مشاوران مالی)

پس از انتخاب توابع هدف و تعیین نوع پردازش کفایت دکمه ی پردازش را انتخاب نمایید. حالا شما به نمودارها و جداولی مطابق نمونه های زیر دسترسی خواهید داشت که تمام آنچه برای آینده نگری سرمایه تان نیاز دارید را به صورت کاملا علمی و دقیق به شما ارائه می کند. برای آشنایی بیشتر با این نمودارها، کمیت ها و مفاهیم از مطالب آموزش وبلاگ سیدبان و یا فیلم های آموزش سیدبان استفاده نمایید.

بسیار مهم :

سیدبان بر اساس آخرین الگوریتم های روز دنیا و پیشرفته ترین متدهای تحلیل پرتفوی، سبد انتخابی شما را ارزیابی می کند. اما این شما هستید که در نهایت بر اساس محاسبات سیدبان، شرایط واقعی بورس کشور و وضعیت اقتصادی موجود، اقدام به خرید سهام می کنید. سیدبان یک ابزار محاسباتی بسیار پیشرفته است و شما را در این مهم یاری می کند، اما به هیچ عنوان قطعیتی در سود یا ضرر به شما ارائه نمی دهد. در مورد مساله ی "عدم قطعیت" در وبسایت سیدبان مطالعه فرمایید.



خروجی	
سبد سهام شرکت های بزرگ	
تاریخ تهیه : 1399/04/02	
پارامترها	
بهترین پرتفوی	
مدل ریسک لودو-ولف	
تابع هدف حداکثر شارپ	
داده های روزانه	
داده ها پس از : 1391/03/11	
درصد نمادها	
دانا	23.41
شیندر	29.98
فولاد	22.54
وہدات	14.63
وہدیر	9.43
نکته سالانه	
بازده مورد انتظار %	59.9
ضریب ریسک :	0.24
نسبت شارپ :	1.68
روزهای دوره :	2942

